



LDB
EMPRESAS

VILA VELHA - CONSOLIDADO
JULHO 2022



Prezados Senhores,

Este documento tem por objetivo apresentar as principais características e informações referente a sua carteira de investimentos, na intenção de ajudá-lo na tomada de decisão e acompanhamento da mesma.

As informações contidas neste documento se destinam somente à orientação de caráter geral e fornecimento de informações sobre o tema de interesse. Nossos estudos são baseados em informações disponíveis ao público, consideradas confiáveis na data de publicação. Dado que as opiniões nascem de julgamentos e estimativas, estão sujeitas a mudanças. Nossos relatórios não representam oferta de negociação de valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros.

Informações adicionais sobre quaisquer empresas, valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros podem ser obtidas mediante solicitação.

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 29.07.2022.

Não é permitido a divulgação e a utilização deste e de seu respectivo conteúdo por pessoas não autorizadas pela LDB CONSULTORIA FINANCEIRA.

Permanecemos à disposição para quaisquer esclarecimentos que se fizerem necessários e muito obrigado,

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA 84,00%

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150822 (16,910000%)	4,47	1,12	1,12	80.894.934,68	15,71
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (5,661000%)	2,94	0,47	8,98	21.273.259,59	4,13
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (5,840000%)	2,95	0,48	9,09	16.113.048,48	3,13
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (6,000000%)	2,95	0,49	3,89	40.363.096,93	7,84
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (6,760000%)	4,17	0,55	1,16	22.253.105,87	4,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (3,680000%) ..	0,58	0,31	7,80	7.470.310,49	1,45
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (4,290000%) ..	0,58	0,36	8,16	380.623,51	0,07
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,100000%) ..	0,58	0,42	8,65	14.782.706,85	2,87
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,730000%)	4,57	0,47	8,43	26.313.750,14	5,11
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,260000%)	0,58	0,43	8,74	21.352.890,93	4,15
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,250000%)	2,83	0,43	8,74	26.939.106,44	5,23
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,270000%)	2,75	0,44	8,75	32.359.483,26	6,29
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,290000%)	2,71	0,44	8,76	26.978.516,45	5,24
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,74	0,64	9,04	337.474.833,62	65,55

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,19	-0,32	5,83	20.579.718,02	4,00	2.597.816.482,92	0,79
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,19	-0,33	5,83	15.421.956,26	3,00	473.736.972,65	3,26
BB	BB	BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	1,73	0,83	8,07	3.747.812,00	0,73	499.702.968,06	0,75
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,57	0,50	9,21	7.846.356,40	1,52	101.482.377,73	7,73
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,68	-0,22	6,22	6.109.291,12	1,19	9.515.072.681,60	0,06
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,76	-0,29	6,10	63.934,80	0,01	10.530.457.571,28	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,16	0,90	5,54	3.252.408,70	0,63	756.882.858,12	0,43
BB	BB	BB PREV RF IPCA	2,28	0,08	7,21	4.411.156,90	0,86	3.068.003.584,32	0,14
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	1,87	0,44	7,32	2.601.340,48	0,51	308.330.603,53	0,84
BB	BB	BB PREV RF VII	1,73	0,82	8,06	1.667.103,79	0,32	260.423.123,57	0,64
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	2,04	0,30	7,04	5.863.394,00	1,14	451.753.494,86	1,30
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO XI TP	1,73	0,82	8,05	7.071.890,98	1,37	216.462.795,32	3,27
SAFRA	SAFRA	SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	0,16	1,03	2,31	4.937.342,39	0,96	3.750.698.852,34	0,13
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,55	0,13	6,78	83.573.705,84	16,23		

Artigo 7º III, Alínea a (Fundos Renda Fixa)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BANESTES	BANESTES	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,15	0,78	4,78	1.910.485,38	0,37	981.762.125,83	0,19
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,17	1,04	5,69	3.936.513,06	0,76	10.247.937.610,00	0,04
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,17	0,95	5,87	1.483.261,62	0,29	3.157.315.937,43	0,05
BANESTES	BANESTES	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,21	0,45	0,45	3.967.823,32	0,77	3.228.816.159,93	0,12
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,21	1,03	4,79	77.512,07	0,02	3.680.023.403,83	0,00
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,13	0,97	6,47	11.375.595,45	2,21		
Renda Fixa			1,68	0,52	7,93	432.424.134,91	84,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

REND A VARIÁVEL

2,70%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA DIVIDENDOS	17,98	1,85	-6,39	3.290.499,03	0,64	230.324.731,46	1,43
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	20,35	4,42	-2,68	267.579,83	0,05	839.233.210,18	0,03
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVSPA	19,88	4,63	-1,46	10.339.752,09	2,01	481.284.828,56	2,15
BB	BB	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	20,54	9,29	-10,18	22.519,72	0,00	1.581.508.167,09	0,00
Sub-total Artigo 8º I			18,36	3,96	-14,52	13.920.350,67	2,70		
Renda Variável			16,43	3,96	-14,52	13.920.350,67	2,70		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

4,89%

Artigo 9º III (Fundos de Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	21,74	7,88	-22,14	16.290.965,93	3,16	2.340.707.282,75	0,70
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	22,27	7,23	-24,76	3.947.304,36	0,77	1.413.581.769,92	0,28
BB	BB	BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	20,58	7,74	-21,75	4.954.721,13	0,96	822.210.804,20	0,60
Sub-total Artigo 9º III			21,09	7,75	-22,43	25.192.991,42	4,89		
Investimentos no Exterior			21,09	7,75	-22,43	25.192.991,42	4,89		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

8,41%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	20,51	10,11	-9,24	43.283.238,25	8,41	2.180.940.739,20	1,98
Sub-total Artigo 10º I			20,51	10,11	-9,24	43.283.238,25	8,41		
Investimentos Estruturados			24,37	10,11	-9,24	43.283.238,25	8,41		
Total			5,09	1,69	1,43	514.820.715,25	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	337.474.833,62	65,55	0,00	40,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	83.573.705,84	16,23	0,00	14,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	11.375.595,45	2,21	0,00	14,00	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	432.424.134,91	84,00					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	13.920.350,67	2,70	0,00	16,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	13.920.350,67	2,70					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	25.192.991,42	4,89	0,00	8,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	25.192.991,42	4,89					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	43.283.238,25	8,41	0,00	8,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	43.283.238,25	8,41					15,00
Total		514.820.715,25	100,00					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,64 62,21	9,04 139,24	3,07 98,83	7,90 138,10	17,01 181,12	2.068.768,84	18.447.120,14
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,13 12,57	6,78 104,51	1,35 43,48	6,62 115,76	8,82 93,98	26.174,70	6.281.333,61
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,97 93,76	6,47 99,60	3,11 100,05	5,76 100,77		135.563,75	2.887.262,11
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	0,00 0,00	0,45 6,90	0,00 0,00	0,37 6,52		0,00	30.909,22
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	3,96 -0,73	-14,52 -12,94	-3,91 0,46	-11,22 -3,21		530.550,30	-5.136.391,71
Artigo 9º III % do CDI	7,75 748,69	-22,43 -345,43	3,92 125,94	-13,47 -235,66	-10,54 -112,26	1.811.559,83	-10.399.275,99
Artigo 10º I % do CDI	10,11 976,53	-9,24 -142,35	2,53 81,24	-4,16 -72,74		3.972.593,07	-4.407.387,28
VILA VELHA - CONSOLIDADO (Total)						8.545.210,49	7.703.570,10

RESULTADO POR ATIVO

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150523 (5,661000%)	21.174.568,88	0,00	0,00	0,00	21.273.259,59	98.690,71	1.792.358,06
NTN-B 150523 (5,840000%)	16.036.039,93	0,00	0,00	0,00	16.113.048,48	77.008,55	1.372.275,12
NTN-B 150523 (6,000000%)	40.165.108,14	0,00	0,00	0,00	40.363.096,93	197.988,79	1.533.185,71
NTN-B 150523 (6,760000%)	22.130.786,97	0,00	0,00	0,00	22.253.105,87	122.318,90	256.011,84
NTN-B 150545 (3,680000%) ..	7.447.388,90	0,00	0,00	0,00	7.470.310,49	22.921,59	549.777,96
NTN-B 150545 (4,290000%) ..	379.270,11	0,00	0,00	0,00	380.623,51	1.353,40	29.259,33
NTN-B 150545 (5,100000%) ..	14.720.660,80	0,00	0,00	0,00	14.782.706,85	62.046,05	1.200.347,66
NTN-B 150545 (5,730000%)	26.190.231,11	0,00	0,00	0,00	26.313.750,14	123.519,03	2.090.186,49
NTN-B 150555 (5,260000%)	21.260.558,39	0,00	0,00	0,00	21.352.890,93	92.332,54	1.751.479,52
NTN-B 150822 (16,910000%)	0,00	79.998.083,19	0,00	0,00	80.894.934,68	896.851,49	896.851,49

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150830 (5,250000%)	26.822.839,40	0,00	0,00	0,00	26.939.106,44	116.267,04	2.175.562,08
NTN-B 150840 (5,270000%)	32.219.301,11	0,00	0,00	0,00	32.359.483,26	140.182,15	2.616.174,99
NTN-B 150850 (5,290000%)	26.861.227,85	0,00	0,00	0,00	26.978.516,45	117.288,60	2.183.649,88
					337.474.833,62	0,00	0,00

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	3.717.130,57	0,00	0,00	0,00	3.747.812,00	30.681,43	280.945,64
BB PREV RF IDKA2	6.122.816,01	0,00	0,00	0,00	6.109.291,12	-13.524,89	357.831,51
BB PREV RF IPCA	4.407.726,08	0,00	0,00	0,00	4.411.156,90	3.430,82	296.792,65
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	2.589.874,88	0,00	0,00	0,00	2.601.340,48	11.465,60	178.007,60
BB PREV RF VII	1.653.484,10	0,00	0,00	0,00	1.667.103,79	13.619,69	124.849,58
BB PREVIDENCIÁRIO RF TIT PUB X FI	5.845.843,27	0,00	0,00	0,00	5.863.394,00	17.550,73	387.123,83
BB PREVIDENCIÁRIO XI TP	7.014.174,54	0,00	0,00	0,00	7.071.890,98	57.716,44	529.289,35
FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.807.476,91	0,00	0,00	0,00	7.846.356,40	38.879,49	665.046,71
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.472.445,40	0,00	0,00	0,00	15.421.956,26	-50.489,14	852.117,28
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	20.645.963,27	0,00	0,00	0,00	20.579.718,02	-66.245,25	1.137.472,65
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	708.993,97	2.976.609,61	-459.252,17	0,00	3.252.408,70	26.057,29	55.470,77
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	33.060.336,96	0,00	-32.900.000,00	0,00	63.934,80	-96.402,16	1.320.311,51
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	7.981.990,93	0,00	-3.098.083,19	0,00	4.937.342,39	53.434,65	152.830,86
					83.573.705,84	0,00	0,00

Artigo 7º III, Alínea a (Fundos Renda Fixa)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	1.440.707,16	7.824.866,60	-7.374.586,48	0,00	1.910.485,38	19.498,10	160.731,41
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	39.043.698,03	3.950.000,00	-39.083.262,33	0,00	3.967.823,32	57.387,62	2.106.743,79
BB PREV RF FLUXO FIC	1.305.448,05	427.829,67	-262.943,61	0,00	1.483.261,62	12.927,51	66.442,05
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	3.896.140,71	0,00	0,00	0,00	3.936.513,06	40.372,35	211.764,68
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	5.072.133,90	0,00	-5.000.000,00	0,00	77.512,07	5.378,17	187.657,03

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
					11.375.595,45	0,00	0,00

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	20.605,70	0,00	0,00	0,00	22.519,72	1.914,02	-4.227.388,48
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	256.260,62	0,00	0,00	0,00	267.579,83	11.319,21	-7.367,32
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	9.882.065,44	0,00	0,00	0,00	10.339.752,09	457.686,65	-1.078.875,90
FIA CAIXA DIVIDENDOS	3.230.868,61	0,00	0,00	0,00	3.290.499,03	59.630,42	-224.500,97
					13.920.350,67	0,00	0,00

Artigo 9º III (Fundos de Ações - BDR Nível I)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	4.598.911,72	0,00	0,00	0,00	4.954.721,13	355.809,41	-4.466.466,41
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	15.101.420,77	0,00	0,00	0,00	16.290.965,93	1.189.545,16	-4.633.591,50
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	3.681.099,10	0,00	0,00	0,00	3.947.304,36	266.205,26	-1.299.218,08
					25.192.991,42	0,00	0,00

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	39.310.645,18	0,00	0,00	0,00	43.283.238,25	3.972.593,07	-4.407.387,28
					43.283.238,25	0,00	0,00

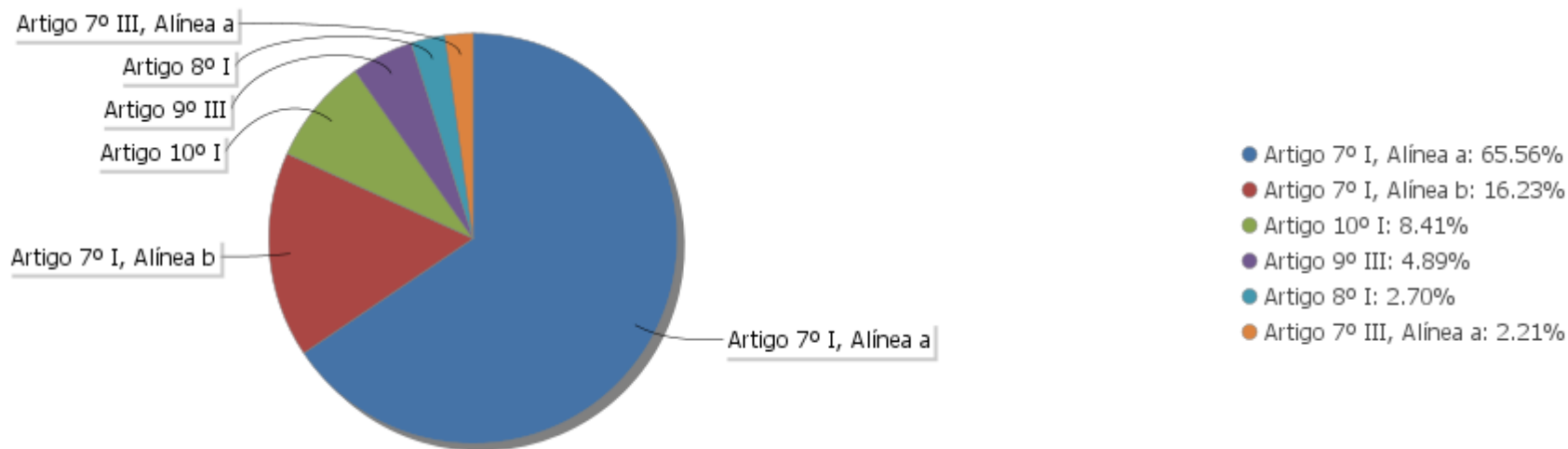
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

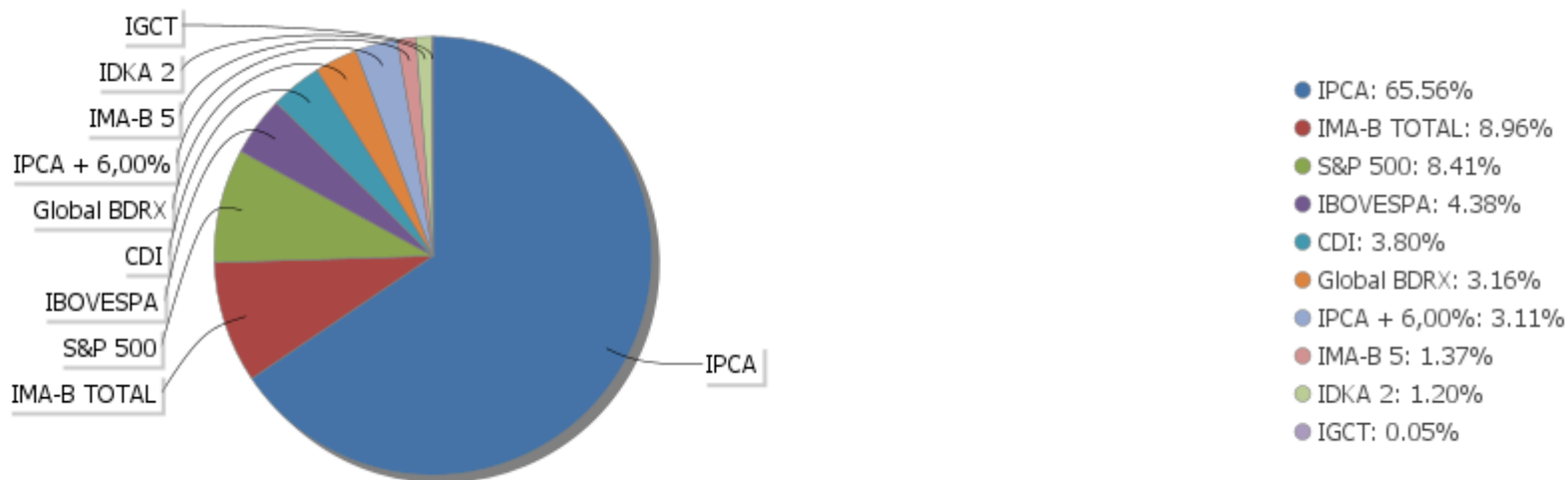
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	209.363.250,65	40,67	209.363.250,65	40,67
de 31 a 365 dias	104.413.667,77	20,28	313.776.918,42	60,95
acima de 365 dias	201.043.796,83	39,05	514.820.715,25	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

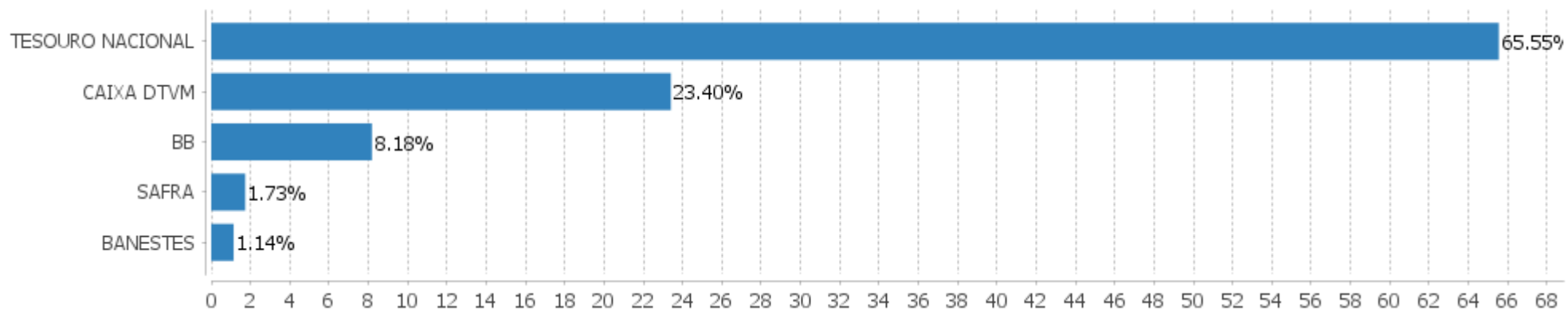


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2022	-1,78	-0,48	1,88	-0,54	0,98	-0,27	1,69						1,43
IPCA + 4,92%	0,94	1,38	2,05	1,43	0,89	1,07	-0,28						7,71
p.p. indexador	-2,72	-1,86	-0,16	-1,97	0,09	-1,35	1,97						-6,27
2021	-0,48	-1,03	1,05	1,06	0,94	0,42	0,32	0,32	-1,16	1,81	0,80	2,14	6,31
IPCA + 5,43%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,28	0,97	1,43	1,34	1,61	1,68	1,37	1,22	16,01
p.p. indexador	-1,15	-2,27	-0,37	0,33	-0,33	-0,56	-1,10	-1,02	-2,77	0,13	-0,57	0,93	-9,70
2020	0,49	-0,79	-6,98	1,89	2,02	2,02	2,94	-0,49	-1,49	-0,01	2,81	3,55	5,63
IPCA + 5,87%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,88	0,72	1,12	1,34	1,35	1,86	10,63
p.p. indexador	-0,22	-1,45	-7,55	1,75	1,95	1,28	2,06	-1,21	-2,61	-1,35	1,46	1,69	-5,00
2019	2,66	0,46	0,52	1,25	2,07	2,43	1,16	-0,08	2,05	2,10	-0,88	2,10	16,97
IPCA + 6,00%	0,83	0,90	1,19	1,06	0,64	0,45	0,72	0,62	0,45	0,63	0,98	1,64	10,59
p.p. indexador	1,83	-0,43	-0,68	0,19	1,43	1,98	0,44	-0,70	1,60	1,47	-1,85	0,46	6,38
2018								0,28	0,40	3,39	0,72	1,12	6,02
IPCA + 6,00%								0,44	0,92	0,96	0,25	0,61	3,23
p.p. indexador								-0,17	-0,52	2,42	0,47	0,51	2,78

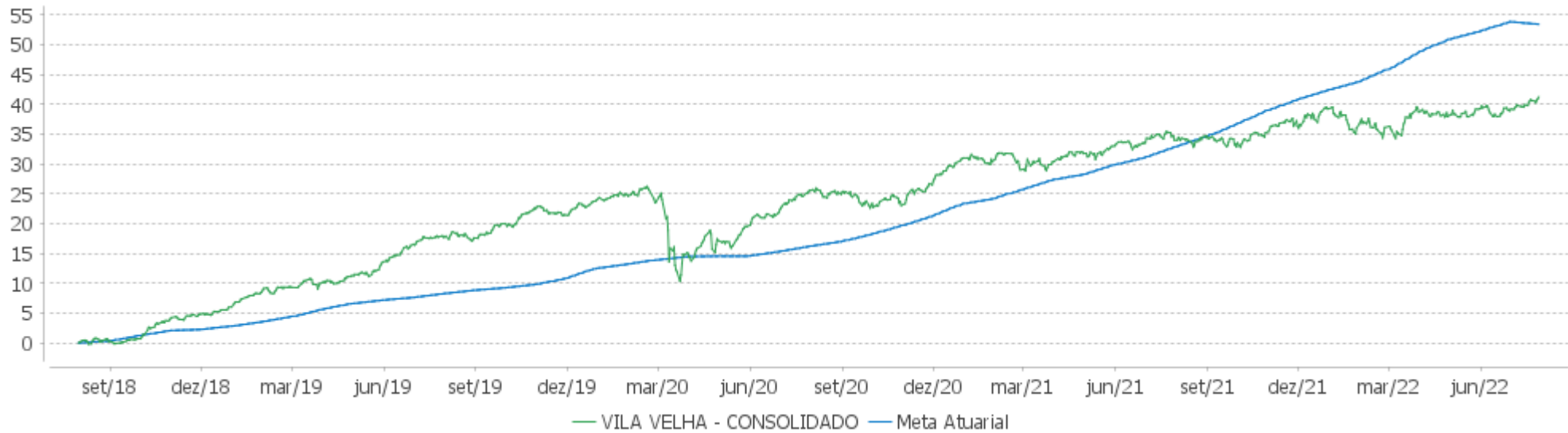
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	22	45,83	03 meses	2,41	1,69	0,72	3,59
Meses abaixo - Meta Atuarial	26	54,17	06 meses	3,27	6,70	-3,43	4,98
			12 meses	5,43	15,70	-10,27	5,09
			24 meses	12,52	33,13	-20,61	4,79
Maior rentabilidade da Carteira	3,55	2020-12	36 meses	20,01	44,30	-24,29	6,27
Menor rentabilidade da Carteira	-6,98	2020-03	48 meses	41,25	57,81	-16,57	5,64
			Desde 31/07/2018	41,25	57,81	-16,57	5,64

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

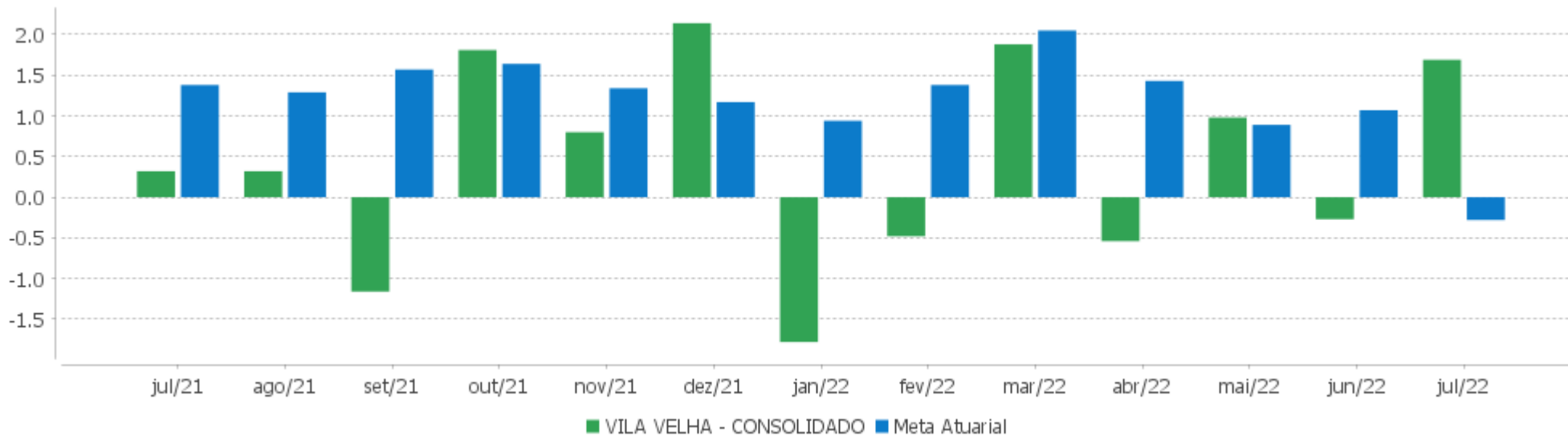


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
NTN-B 150523 (6,000000%) Var. IPCA p.p.	0,49 1,17	9,18 4,41	3,01 2,55	7,93 3,72	14,28 4,21	24,10 4,13	26,88 4,15
NTN-B 150545 (5,100000%) .. Var. IPCA p.p.	0,42 1,10	8,65 3,88	2,78 2,33	7,48 3,27	16,66 6,59	33,15 13,18	43,06 20,33
NTN-B 150850 (5,290000%) Var. IPCA p.p.	0,44 1,12	8,76 3,99	2,83 2,37	7,57 3,37	13,82 3,75	23,46 3,49	26,08 3,34
NTN-B 150523 (5,840000%) Var. IPCA p.p.	0,48 1,16	9,09 4,32	2,97 2,51	7,85 3,64	14,11 4,04	23,76 3,79	26,38 3,64
NTN-B 150545 (3,680000%) .. Var. IPCA p.p.	0,31 0,99	7,80 3,03	2,43 1,97	6,76 2,56	15,09 5,02	29,60 9,63	37,36 14,62
NTN-B 150555 (5,260000%) Var. IPCA p.p.	0,43 1,11	8,74 3,97	2,82 2,37	7,56 3,35	16,84 6,77	26,76 6,79	29,47 6,74
NTN-B 150830 (5,250000%) Var. IPCA p.p.	0,43 1,11	8,74 3,97	2,82 2,37	7,55 3,35	13,64 3,57	22,91 2,94	25,18 2,45
NTN-B 150822 (16,910000%) Var. IPCA p.p.	1,32 2,00	12,04 7,27	5,60 5,15	9,86 5,65	21,85 11,78	44,34 24,37	60,20 37,47
NTN-B 150523 (5,661000%) Var. IPCA p.p.	0,47 1,15	8,98 4,21	2,92 2,47	7,76 3,55	13,93 3,86	23,38 3,41	25,81 3,07
NTN-B 150545 (4,290000%) .. Var. IPCA p.p.	0,36 1,04	8,16 3,39	2,58 2,13	7,07 2,86	15,76 5,69	31,12 11,15	39,79 17,05
NTN-B 150840 (5,270000%) Var. IPCA p.p.	0,44 1,12	8,75 3,98	2,83 2,37	7,56 3,36	13,75 3,68	23,26 3,29	25,75 3,01
NTN-B 150545 (5,730000%) Var. IPCA p.p.	0,47 1,15	9,02 4,25	2,94 2,48	8,15 3,94	14,10 4,03	23,84 3,87	26,55 3,82
NTN-B 150523 (6,760000%) Var. IPCA p.p.	0,55 1,23	6,46 1,69	0,21 -0,24	5,18 0,97	11,73 1,66	22,09 2,12	25,58 2,84
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,44 1,32	7,32 3,88	1,46 1,74	6,92 2,73	10,97 7,72	17,11 11,24	28,27 13,77
BB PREVIDENCIÁRIO XI TP Var. IMA-B 5 p.p.	0,82 0,81	8,05 1,43	1,79 0,66	7,45 0,95	11,95 1,91	19,70 4,09	30,11 4,30
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,83 1,02	8,07 -0,27	1,80 -0,16	7,46 0,22	11,98 -4,67	19,66 -15,04	29,36 -16,75
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	1,03	6,44	3,13	5,64	9,36	11,73	16,21

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	99,70	99,19	100,71	98,62	99,65	97,30	96,55
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,90	5,54	2,69	4,90	7,81	9,48	13,15
% do CDI	87,35	85,29	86,50	85,68	83,15	78,70	78,29
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	0,30	7,04	1,33	6,73	10,60	16,16	25,98
Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,18	3,61	1,62	2,53	7,35	10,30	11,48
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	-0,33	5,83	0,78	5,86	8,99	12,10	24,62
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,55	2,40	1,07	1,66	5,74	6,24	10,13
FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,50	9,21	3,02	7,95	17,69	35,39	42,85
Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,69	0,86	1,07	0,71	1,04	0,68	-3,26
BB PREV RF VII	0,82	8,06	1,79	7,45	11,96	19,27	26,12
Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,70	4,63	2,08	3,26	8,71	13,41	11,63
BB PREV RF IDKA2	-0,22	6,22	0,82	6,21	9,51	15,66	24,90
Var. IDKA 2 p.p.	-0,05	-0,44	-0,33	-0,40	-0,60	-0,93	-1,81
BB PREV RF IPCA	0,08	7,21	0,92	7,11	10,41	15,65	27,48
Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,27	-1,13	-1,04	-0,12	-6,24	-19,05	-18,64
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	-0,32	5,83	0,79	5,86	9,00	12,11	24,64
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,56	2,40	1,07	1,67	5,75	6,25	10,15
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	-0,29	6,10	0,78	6,08	9,41	15,38	24,72
Var. IDKA 2 p.p.	-0,12	-0,56	-0,37	-0,53	-0,70	-1,21	-1,99
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	1,04	6,80	3,23	6,00	10,06	13,98	15,22
% do CDI	100,35	104,74	103,91	104,93	107,16	116,03	90,64
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1,04	6,64	3,16	5,81	9,68	12,43	16,64
% do CDI	100,13	102,22	101,60	101,57	103,11	103,16	99,06
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,78	4,78	2,34	4,24	6,57	7,31	8,76
% do CDI	75,64	73,58	75,34	74,20	69,97	60,63	52,16
BB PREV RF FLUXO FIC	0,95	5,87	2,86	5,18	8,24	9,65	13,07
% do CDI	91,86	90,37	91,99	90,61	87,71	80,03	77,84
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	1,03	6,77	3,19	5,88	9,85	12,51	17,02
% do CDI	99,06	104,33	102,47	102,78	104,90	103,77	101,33
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	4,63	-1,46	-4,21	-7,84	-15,24	0,04	0,95
Var. IBOVESPA p.p.	-0,06	0,13	0,15	0,17	0,06	-0,20	-0,38
FIA CAIXA DIVIDENDOS	1,85	5,97	-2,86	-1,18	-2,31	8,41	7,75
Var. IBOVESPA p.p.	-2,85	7,55	1,51	6,82	12,99	8,16	6,43
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	9,29	-10,18	1,86	-5,05	-0,88	32,84	
Var. IBOVESPA p.p.	4,60	-8,60	6,23	2,96	14,42	32,59	
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	4,42	-2,68	-5,19	-8,79	-17,73	-1,62	1,81

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IGCT p.p.	-0,09	-0,55	-0,16	-0,40	-0,72	-1,87	-2,81
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	7,88 0,23	-22,14 -0,07	3,94 0,13	-13,74 -0,16	-11,05 -0,39	16,19 -2,81	80,64 -4,31
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	7,74 3,05	-21,75 -20,17	3,70 8,07	-12,46 -4,45	-9,00 6,30	16,47 16,23	72,50 71,17
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB Var. IBOVESPA p.p.	7,23 2,54	-24,76 -23,18	4,08 8,45	-14,77 -6,76	-14,16 1,14	15,43 15,19	61,88 60,55
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	10,11 2,03	-9,24 10,19	2,53 -2,91	-4,16 7,26	1,13 5,93	36,18 10,28	46,79 -44,19
VILA VELHA - CONSOLIDADO Var. IPCA + 4,92% p.p.	1,69 1,97	1,43 -6,27	2,41 0,72	3,27 -3,43	5,43 -10,03	12,52 -19,47	20,01 -21,69
CDI	1,03	6,49	3,11	5,72	9,39	12,05	16,79
IBOVESPA	4,69	-1,58	-4,37	-8,01	-15,30	0,25	1,33
INPC + 6,00%	-0,12	8,56	1,96	7,31	16,71	35,83	47,90
IPCA + 6,00%	-0,20	8,34	1,95	7,24	16,65	34,70	46,11

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	D+0	D+0	D+0	D+0		1,70
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du		1,60
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BB PREV RF FLUXO FIC	D+0	D+0	D+0	D+0		1,00
BB PREV RF IDKA2	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IPCA	D+0	D+0	D+0	D+0		0,15
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BB PREV RF VII	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BB PREVIDENCIÁRIO XI TP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+0	D+0	D+0	D+1 du		1,20
FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,80
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,50
FIA CAIXA DIVIDENDOS	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,70
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du		1,50

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI			D+0	D+0		0,10

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	1,05	6,09	2,96	5,43	8,11	10,26	16,33	24,81	34,03
IRF-M 1+	1,20	1,94	1,68	2,45	1,01	-2,37	9,37	29,67	40,37
IRF-M TOTAL	1,15	3,36	2,11	3,45	3,42	1,97	11,97	29,08	39,48
IMA-B 5	0,01	6,62	1,13	6,50	10,04	15,61	25,82	43,53	55,41
IMA-B 5+	-1,84	0,16	-1,79	1,79	-3,22	-2,89	4,70	45,06	51,68
IMA-B TOTAL	-0,88	3,43	-0,28	4,20	3,25	5,86	14,50	45,94	55,35
IMA-GERAL TOTAL	0,47	4,98	1,83	4,76	5,95	7,72	15,62	33,41	43,39
IDKA 2	-0,17	6,66	1,15	6,61	10,11	16,59	26,71	42,67	55,48
IDKA 20	-3,59	-6,10	-5,30	-3,27	-15,47	-16,49	-12,36	41,45	43,04
CDI	1,03	6,49	3,11	5,72	9,39	12,05	16,79	24,21	33,01

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	4,69	-1,58	-4,37	-8,01	-15,30	0,25	1,33	30,22	56,50
IBRX 100	4,40	-1,57	-4,69	-7,90	-16,32	1,03	3,22	35,06	60,67
IBRX 50	4,54	-1,43	-4,61	-8,44	-15,95	2,74	2,97	30,16	56,41
SMALL CAP	5,16	-15,55	-13,62	-18,34	-32,57	-19,00	-12,63	25,78	39,30
IFIX	0,66	0,33	0,04	1,34	-0,35	2,96	5,81	30,62	36,20
Índice Consumo - ICON	9,18		-9,26	-19,73	-38,06	-36,23	-28,49	-1,52	0,77
Índice Dividendos - IDIV	1,98	6,66	-2,58	-0,76	-0,49	13,65	17,63	66,49	85,47

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	-0,68	4,77	0,46	4,21	10,07	19,97	22,74	26,69	32,37
INPC	-0,60	4,98	0,47	4,28	10,12	20,98	24,23	28,16	32,79
IGPM	0,21	8,39	1,32	6,45	10,08	47,31	60,97	71,26	85,37
SELIC	1,03	6,49	3,11	5,72	9,39	12,05	16,79	24,21	33,03

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	8,08	-19,43	5,43	-11,42	-4,80	25,90	90,98	102,65	177,09
MSCI ACWI	5,85	-21,45	2,90	-13,91	-10,79	15,22	67,60	69,52	121,29

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	-0,35	7,16	1,46	6,24	14,45	29,70	38,02	48,12	60,90
IPCA + 5,00%	-0,28	7,75	1,71	6,74	15,55	32,19	42,03	53,87	68,75
IPCA + 5,50%	-0,24	8,05	1,83	6,99	16,10	33,44	44,06	56,81	72,78
IPCA + 5,89%	-0,21	8,28	1,93	7,18	16,53	34,43	45,66	59,14	75,99
IPCA + 6,00%	-0,20	8,34	1,95	7,24	16,65	34,70	46,11	59,80	76,90
INPC + 4,00%	-0,27	7,37	1,47	6,31	14,51	30,79	39,70	49,84	61,41
INPC + 6,00%	-0,12	8,56	1,96	7,31	16,71	35,83	47,90	61,65	77,45

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1558	01/07/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	35.991,40	0,00	4.164,19261314	8,6430680200
1589	01/07/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	35.991,40	17.698,35002129	2,0336020000
1576	04/07/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	84.289,58	0,00	9.748,69662530	8,6462409500
1568	04/07/2022	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,00	3.858.937,46	2.003.161,49583596	1,9264235400
1567	04/07/2022	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,00	35.224.324,87	18.284.828,92708007	1,9264235400
1587	04/07/2022	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	32.900.000,00	12.358.975,26439379	2,6620330000
1588	04/07/2022	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,00	5.000.000,00	3.112.964,50099802	1,6061860000
1604	04/07/2022	SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	0,00	3.098.083,19	5.878,27982320	527,0390800000
1605	04/07/2022	NTN-B 150822 (16,910000%)	79.998.083,19	0,00	19.848,00000000	4.030,5362350000
1594	05/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	17.334,71	7.560,60930700	2,2927662700
1595	06/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	1.264,07	0,00	551,07783000	2,2938139220
1596	07/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	17.894,55	7.797,68609700	2,2948538550
1590	07/07/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	2.976.609,61	0,00	1.461.216,76854472	2,0370760000
1578	07/07/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	988,33	0,00	114,17957612	8,6559263400
1591	08/07/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	82.747,71	40.603,40538286	2,0379500000
1597	12/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	9.923,26	4.318,30404200	2,2979530630
1554	12/07/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	236.443,54	27.285,34604753	8,6655870000
1570	12/07/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	25.740,13	2.970,38504273	8,6655870000
1598	14/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	6.684,19	2.906,13748000	2,3000253930
1555	14/07/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	64.657,86	7.455,85574594	8,6720910700
1571	14/07/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	10.681,37	1.231,69486106	8,6720910700
1599	15/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	4.380,00	1.903,46998900	2,3010607080
1592	15/07/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.544,80	756,39246624	2,0423260000
1560	18/07/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	478.709,89	0,00	55.160,32620490	8,6785181100
1580	18/07/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	816.090,79	0,00	94.035,73046970	8,6785181100
1569	18/07/2022	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	3.950.000,00	0,00	2.040.580,88218930	1,9357233200
1562	19/07/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	34.581,72	0,00	3.983,26229289	8,6817581800
1583	19/07/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	320.908,83	0,00	36.963,57618985	8,6817581800

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1600	20/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	304,88	132,31764700	2,3041522120
1584	20/07/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	186,87	0,00	21,51651552	8,6849564400
1601	22/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	426.565,60	0,00	184.962,36674900	2,3062291400
1556	22/07/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	54.484,73	6.268,72059313	8,6915231300
1572	22/07/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	380.910,73	43.825,54409825	8,6915231300
1585	25/07/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	1.434,93	0,00	165,03630762	8,6946322300
1564	26/07/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	6.049.207,52	0,00	695.484,93986247	8,6978267600
1586	26/07/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	2.476,74	0,00	284,75388954	8,6978267600
1602	28/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	149.687,26	64.789,49045500	2,3103632850
1557	28/07/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	543.816,42	62.477,56821803	8,7041867900
1563	28/07/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	34.671,06	3.983,26229289	8,7041867900
1561	28/07/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	480.125,78	55.160,32620490	8,7041867900
1559	28/07/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	36.245,91	4.164,19261314	8,7041867900
1565	28/07/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	4.452.711,37	511.559,72147974	8,7041867900
1575	28/07/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	413,50	47,50582228	8,7041867900
1581	28/07/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	476.449,94	54.738,01876205	8,7041867900
1574	28/07/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	431,90	49,61997178	8,7041867900
1573	28/07/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	131.785,67	15.140,49155399	8,7041867900
1579	28/07/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	993,84	114,17957612	8,7041867900
1577	28/07/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	84.854,48	9.748,69662530	8,7041867900
1603	29/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	56.734,76	24.545,55173500	2,3114069960
1566	29/07/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	343.128,24	39.406,47846089	8,7074068400
1593	29/07/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	338.968,26	165.261,29731091	2,0511049200
1582	29/07/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	16.040,01	1.842,11100951	8,7074068400
Total			95.177.389,07	88.178.127,78		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0%

Value-At-Risk (R\$): 10.039.648,78

Value-At-Risk: 1,95%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
VILA VELHA - CONSOLIDADO		1,95	1,95			514.820.715,25	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,32%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150822 (16,910000%)		0,31	0,00	0,30			80.894.934,68	15,71
NTN-B 150523 (5,661000%)		0,31	0,00	0,30			21.273.259,59	4,13
NTN-B 150523 (5,840000%)		0,31	0,00	0,30			16.113.048,48	3,13
NTN-B 150523 (6,000000%)		0,31	0,00	0,30			40.363.096,93	7,84
NTN-B 150523 (6,760000%)		0,29	0,00	0,38			22.253.105,87	4,32
NTN-B 150545 (3,680000%) ..		0,31	0,00	0,30			7.470.310,49	1,45
NTN-B 150545 (4,290000%) ..		0,31	0,00	0,30			380.623,51	0,07
NTN-B 150545 (5,100000%) ..		0,31	0,00	0,30			14.782.706,85	2,87
NTN-B 150545 (5,730000%)		0,31	0,00	0,41			26.313.750,14	5,11
NTN-B 150555 (5,260000%)		0,31	0,00	0,30			21.352.890,93	4,15
NTN-B 150830 (5,250000%)		0,31	0,00	0,30			26.939.106,44	5,23
NTN-B 150840 (5,270000%)		0,31	0,00	0,30			32.359.483,26	6,29
NTN-B 150850 (5,290000%)		0,31	0,00	0,30			26.978.516,45	5,24
Sub-total	0,50	0,27	0,01		-0,78	0,64	337.474.833,62	65,55

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		1,66	0,02	1,11			20.579.718,02	4,00
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF		1,66	0,02	1,11			15.421.956,26	3,00
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI		0,98	0,00	0,97			3.747.812,00	0,73

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,31	0,00	0,30			7.846.356,40	1,52
BB PREV RF IDKA2		1,34	0,00	0,29			6.109.291,12	1,19
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,48	0,00	0,39			63.934,80	0,01
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF		0,03	-0,00	0,00			3.252.408,70	0,63
BB PREV RF IPCA		0,97	0,00	0,93			4.411.156,90	0,86
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI		0,84	0,00	1,78			2.601.340,48	0,51
BB PREV RF VII		0,98	0,00	2,14			1.667.103,79	0,32
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI		0,94	0,00	1,64			5.863.394,00	1,14
BB PREVIDENCIÁRIO XI TP		0,98	0,00	1,05			7.071.890,98	1,37
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI		0,04	0,00	0,02			4.937.342,39	0,96
Sub-total	1,91	1,02	0,05		-0,47	0,13	83.573.705,84	16,23

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO		0,02	-0,00	0,01			1.910.485,38	0,37
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,04	0,00	0,03			3.936.513,06	0,76
BB PREV RF FLUXO FIC		0,03	-0,00	0,01			1.483.261,62	0,29
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI		0,04	0,00	0,04			3.967.823,32	0,77
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI		0,04	-0,00	0,03			77.512,07	0,02
Sub-total	0,03	0,03	0,00		-1,96	0,97	11.375.595,45	2,21

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 14,90%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		14,90	1,22	8,74			43.283.238,25	8,41
Sub-total	18,76	14,90	1,22		0,48	10,11	43.283.238,25	8,41

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 12,34%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		12,98	0,33	3,19			16.290.965,93	3,16
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB		11,83	0,07	12,86			3.947.304,36	0,77
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I		11,49	0,09	12,39			4.954.721,13	0,96
Sub-total	22,69	12,34	0,49		0,30	7,75	25.192.991,42	4,89

Renda Variável

Value-At-Risk: 9,23%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA DIVIDENDOS		7,87	0,03	4,62			3.290.499,03	0,64
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI		9,53	0,00	0,10			267.579,83	0,05
FIA CAIXA BRASIL IBOVSPA		9,87	0,14	0,19			10.339.752,09	2,01
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA		16,26	0,00	11,36			22.519,72	0,00
Sub-total	15,19	9,23	0,18		0,19	3,96	13.920.350,67	2,70